

市场概述

Market Overview

CFETS ICAP

【每日市场动态 20170424】现券收益率继续上涨

文/ Vivian Shen

CFETS-ICAP 2017/04/24

今日央行公开市场逆回购共计投放 300 亿，无逆回购到期，资金净投放 300 亿。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.7157%，上涨 9.94 个基点；7 天品种报 2.7900%，上涨 3.00 个基点；1 个月品种报 4.0100%，上涨 0.05 个基点；3 个月品种报 4.2789%，上涨 0.08 个基点。今日银行间市场资金面依旧紧张，早盘隔夜、7 天需求旺盛，大行鲜有融出，资金价格偏高；下午 15 时后有部分银行融出，隔夜资金逐渐宽松，尾盘更有机构有减点融出，然而 7 天跨月资金依旧维持紧势；1 个月及以上资金卖盘较多，但成交一般。

今日农发行发行的 3 年期、7 年期、15 年期固息增发债中标收益率分别为 4.0253%、4.3805%、4.5026%，全场倍数分别为 2.41、3.69、2.9 倍，边际倍数分别为 2.71、4.43、2.35 倍。国债期货

早盘低开弱势震荡，午后下行剧烈，尾盘大幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 95.390，跌 0.48%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.140，跌 0.29%。受月末流动性收敛、监管力度升级以及货币基金逆回购交易违约传闻的冲击，今日债市情绪依旧谨慎，现券收益率高开高走，震荡上行，截至目前，剩余期限 9.34 年的国开债活跃券 160213 收益率报 4.33%/4.32%；剩余期限 9.80 年的国债活跃券 170004 收益率报 3.50%/3.475%。

周一人民币兑美元中间价报 6.8673，上调 150 点。在岸人民币兑美元早盘先走强后震荡下跌，午后小幅走强，截止 16:30，报收 6.8864，较上一交易日收盘价跌 26 点；离岸人民币兑美元震荡下跌，但仍维持强势，现报 6.8864，较上一交易日收盘价涨 30 点，两岸汇差现在 7 点

附近。美元指数维持震荡，现报 99.03，
涨 0.33%。

上周五（4 月 21 日）CFETS 人民币汇
率指数录得 92.98，按周下跌 0.20；参
考 BIS 货币篮子和 SDR 货币篮子的人民
币汇率指数分别录得 93.96 和 94.71，按
周分别下跌 0.20 和 0.58。

以上仅供参考，谢谢！

如果您对本文有任何评论和见解

请发电邮至：shmarketing@cfets-icap.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-icap.com.cn

免责声明 文中信息均来源于公开资料，上海国际货币经纪有限责任公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，内容和意见仅供参考。本文仅反映作者个人观点，并不代表公司的看法。